

Stopy zwrotu strategii asset management

NAZWA FIRMY ASSET MANAGEMENT	NAZWA PORTFELA/STRATEGII	STOPA ZWROTU BRUTTO Z PORTFELA (PROC.)							NAZWA STOSOWANEGO BENCHMARKU	STOPA ZWROTU Z BENCHMARKU (PROC.)		
		styczeń- marzec 2024 r. (kwartałna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	kwiecień 2023- marzec 2024 (roczna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	trzy- letnia stopa zwrotu	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	pięcio- letnia stopa zwrotu		styczeń- marzec 2024 r. (od początku roku)	kwiecień 2023- marzec 2024 (roczna)	trzy- letnia stopa zwrotu
mBank Asset Management	Portfel Funduszy Zrównoważony Odpowiedzialnego Inwestowania*	2,46	-2,56	7,37	-4,34	b.d.	b.d.	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Glob Aggr + 10 proc. POLONIA - 1,95 proc. p.a.	5,02	11,71	b.d.
Caspar Asset Management	Strategia Focus Zrównoważona	7,13	0,33	6,08	-6,14	4,84	-18,99	64,28	60 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 40 proc. WIBOR 6M	6,80	12,22	23,83
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Zrównoważona	2,14	-6,45	1,73	-9,66	b.d.	b.d.	b.d.	50 proc. średnia funduszy papierów dłużnych globalnych uniwersalnych + 50 proc. średnia funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych	8,59	11,39	b.d.
Portfele mieszane – stabilnego wzrostu (udział akcji do 40 proc.)												
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Stabilnego Wzrostu	2,23	0,81	17,54	2,59	12,99	-3,54	17,11	30 proc. WIG20 + 70 proc. WIBID 6M	1,42	14,95	16,53
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dekada	2,50	0,70	16,46	3,76	13,54	-5,64	18,50	20 proc. WIG + 80 proc. WIBID 6M	1,8	12,7	19,18
BM Banku BNP Paribas	Stabilny PLN	1,43	-0,15	14,42	-1,44	13,80	7,55	30,46	17,5 proc. WIG20 + 7,5 proc. mWIG40 + 75 proc. TBSP.Index	1,58	15,86	6,25
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia dochodowa	2,63	0,38	14,32	0,82	3,30	-2,87	19,39	10 proc. subfundusz Skarbiec Akcja + 10 proc. subfundusz Skarbiec Małych i Średnich Spółek + 40 proc. subfundusz Skarbiec Obligacja + 40 proc. subfundusz Skarbiec Krótkoterminowy. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy mieszanych polskich stabilnego wzrostu zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Anality Online	2,25	13,5	6,17
mBank Asset Management	Portfel Funduszy Stabilnego Wzrostu*	2,67	1,24	9,84	0,43	10,44	8,10	19,61	20 proc. WIG20 + 20 proc. WIBID ON + 5 proc. MSCI ACWI + 55 proc. Bloomberg/EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All > 1 Yr	1,43	9,41	2,34
Superfund TFI	Strategia Konserwatywny Portfel	1,20	-0,79	8,15	-0,64	10,38	-4,69	15,15	5 proc. WIG + 60 proc. WIBID 1M + 30 proc. Bloomberg/EFFAS Bond Indices Poland Govt All > 1Yr TR + 5 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe onoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	1,99	8,79	15,07
Superfund TFI	Strategia Konserwatywna	1,58	-1,04	7,52	-0,95	15,79	6,44	18,11	5 proc. WIG + 90 proc. WIBID 1M + 5 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	2,62	8,47	9,35
mBank Asset Management	Dochodowa 2.0	1,00	-0,19	7,36	-0,80	6,03	4,49	14,41	40 proc. BB Glob Aggr + 35 proc. BB Pol Govt + 10 proc. MSCI ACWI + 5 proc. WIG + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	1,19	8,16	1,54
mBank Asset Management	Antyinflacyjna	0,53	-0,98	5,01	-1,83	11,70	-1,07	b.d.	65 proc. BB World Govt Infl. 1-5 + 10 proc. MSCI World Value + 10 proc. FTSE Global REIT + 10 proc. BB Commodity Index + 5 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	1,51	6,84	12,77
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – stabilnego wzrostu (udział akcji do 40 proc.)												
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Stabilnego Wzrostu Globalna ETF + Obligacje	2,78	-1,00	7,63	-0,51	7,82	-7,47	b.d.	30 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 70 proc. stopa referencyjna NBP	3,78	8,14	15,29
BM Banku BNP Paribas	Stabilny EUR**	2,05	0,09	6,84	-0,73	0,75	3,67	10,60	10 proc. EONIA + 43 proc. Bloomberg Barclays Series-E Euro Govt All > 1 Yr Bond Index + 22 proc. FTSE Euro Corporate AA Index + 10 proc. STOXX Europe 600 + 8 proc. S&P 500 + 1 proc. Topix + 6 proc. MSCI EM	1,96	7,57	-2,92
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Dochodowa	1,53	0,17	6,10	-2,43	b.d.	b.d.	b.d.	70 proc. średnia funduszy papierów dłużnych globalnych uniwersalnych + 30 proc. średnia funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych	1,36	8,53	b.d.
BM Banku BNP Paribas	Stabilny USD**	1,36	0,16	5,49	-0,17	-0,98	-0,20	13,81	10 proc. GS Overnight Money Market USD + 43 proc. Bloomberg Barclays Series-E US Govt All > 1 Yr Bond Index + 22 proc. Bloomberg US Corporate Bond Index + 8 proc. STOXX Europe 600 + 10 proc. S&P500 + 1 proc. Topix + 6 proc. MSCI EM	1,20	5,66	-0,78
Caspar Asset Management	Strategia Focus Stabilnego Wzrostu	4,33	0,20	4,16	-5,06	2,03	-17,75	32,33	30 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 70 proc. WIBOR 6M	4,13	9,22	19,78
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Stabilnego Wzrostu Risk Parity	4,32	-1,44	-0,56	-5,53	0,93	-16,47	b.d.	40 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 60 proc. Federal Funds Target Rate – Lower Bound (FDTRFTRL)	5,76	4,97	17,40
Portfele o zmiennej alokacji aktywów												
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Aktywnej Alokacji	2,03	0,65	26,92	20,67	35,93	22,08	29,78	WIBID 6M	1,38	6,25	13,85
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zysk Absolutny	3,36	1,98	25,19	18,94	32,84	18,99	45,31	WIBID 6M	1,38	6,25	13,85
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny Aktywnej Alokacji PLN	2,71	-0,20	21,20	-2,41	29,37	14,71	b.d.	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	2,91	23,61	14,66
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony Aktywnej Alokacji PLN	2,15	-0,23	18,17	-2,34	22,16	10,87	b.d.	28 proc. WIG20 + 12 proc. mWIG40 + 60 proc. TBSP.Index	2,38	20,51	11,29
BM Banku BNP Paribas	Stabilny Aktywnej Alokacji PLN	1,35	0,04	13,37	-0,94	11,68	7,12	b.d.	14 proc. WIG20 + 6 proc. mWIG40 + 80 proc. TBSP.Index	1,31	14,31	4,56
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia absolute return	2,38	b.d.	11,57	b.d.	-0,88	b.d.	15,71	0 pkt proc. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: WIBOR 12M + 250 pkt baz.	b.d.	b.d.	b.d.
mBank Asset Management	MultiAsset	1,71	-1,63	9,78	-4,95	11,32	-4,99	26,33	40 proc. (POLONIA + 2,5 proc.) + 15 proc. WIG + 25 proc. MSCI ACWI + 20 proc. BB Glob Aggr - 1 proc. p.a.	3,34	14,73	16,31
Superfund TFI	Strategia PRP Portfel Absolutnej stopy zwrotu (brutto)	1,39	-2,15	6,29	-7,52	13,99	-1,19	15,78	WIBID 1M	3,54	13,81	15,18
Portfele dłużne oraz rynku pieniężnego												
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Polskich Obligacji Skarbowych 01	3,23	1,80	14,90	8,69	32,77	18,73	b.d.	Stopa referencyjna NBP	1,43	6,21	14,04
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Polskich Obligacji Skarbowych 02	3,18	1,75	11,69	5,48	b.d.	b.d.	b.d.	Stopa referencyjna NBP	1,43	6,21	b.d.
Quercus TFI	Strategia Dłużna Krótkoterminowa	1,62	0,13	8,90	2,52	15,62	0,83	b.d.	WIBID3M + 30 pkt. bazowych	1,49	6,38	14,79
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Ochrona	2,02	0,64	8,59	2,34	2,52	-11,33	12,56	WIBID 6M	1,38	6,25	13,85
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Indywidualna Obligacji	2,34	0,91	8,33	2,12	b.d.	b.d.	b.d.	Stopa referencyjna NBP	1,43	6,21	b.d.
BM Banku BNP Paribas	Konserwatywny PLN	0,41	0,17	8,29	0,18	0,61	2,77	9,46	TBSP Indeks	0,24	8,11	-2,16
mBank Asset Management	Portfel Funduszy Konserwatywny*	1,39	1,16	8,13	7,03	8,76	6,42	14,35	WIBID O/N 20 proc. Bloomberg/EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All > 1 Yr 80 proc.	0,23	1,1	2,34
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia płynnościowa	1,08	-0,02	6,79	0,12	0,83	-7,74	7,30	50 proc. subfundusz Skarbiec Konserwatywny + 50 proc. subfundusz Skarbiec Krótkoterminowy. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy dłużnych polskich papierów skarbowych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Anality Online	1,1	6,67	8,57
mBank Asset Management	Ochrony Kapitału	0,02	-0,37	5,16	-0,95	2,21	2,96	7,98	20 proc. BB Glob Aggr + 70 proc. BB Pol Govt + 10 proc. POLONIA – 0,8 proc. p.a.	0,39	6,11	-0,75
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Dłużna	1,32	-5,54	0,85	-3,48	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. średnia funduszy papierów dłużnych globalnych uniwersalnych	6,86	4,33	b.d.
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Konserwatywna	0,44	-8,44	0,4	-7,73	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. średnia funduszy papierów dłużnych polskich skarbowych	8,88	8,13	b.d.
Portfele alternatywne												
Superfund TFI	Strategia Managed Futures	0,89	-5,62	-1,07	1,75	15,61	43,03	24,85	Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	6,51	-2,82	-27,42

* wyniki netto, ** Stopa zwrotu brutto portfela modelowego liczona w walucie wyceny portfela. Źródło: spółki. Sortowanie wg rocznej stopy zwrotu